ОСНОВЫ ТРЕЙДИНГА

ТОМ 2

ПРАКТИКА

Методическое пособие
для начинающих трейдеров

Игорь Арапов

arapov.trade
2025
ISBN: 979-8-90243-078-0

Основы Трейдинга

Методическое пособие для начинающих трейдеров

ТОМ 2

Игорь Арапов

arapov.trade

2025

ISBN: 979-8-90243-078-0

Содержание

Титульная страница

Вступление

- Содержание

Часть I. Технический анализ рынка

- Раздел 1. Основные фазы рыночного движения
- Раздел 2. Уровни смены приоритета
- Раздел 3. Характеристики разворотных движений

Часть II. Объёмный анализ

- Раздел 4. Применение объёмов

Часть III. Метод входа в рынок

- Раздел 5. Определение метода входа

Часть IV. Контроль рисков

- Раздел 6. Управление капиталом
- Раздел 7. Страх и надежда

Часть V. Математическая модель

- Раздел 8. Прибыльная торговая система

Часть VI. Практика

- Раздел 9. Торговая стратегия

Примеры торговой системы

Заключение

Дисклеймер

Ориентиры

Обложка

Содержание

Титульная страница

Начало книги

Заключение

Список иллюстраций

1. Рис. 1. Фаза баланса (равновесия)
2. Рис. 2. Фаза тренда (дисбаланса)

Дорогой читатель!

Ты держишь в руках второй том курса «Основы трейдинга — методическое пособие для начинающих трейдеров».

Если ты не изучал первый том — настоятельно рекомендую начать с него. Там заложен фундамент: понимание рынка, базовые концепции, логика движения цены. Без этого двигаться дальше будет тяжело.

В отличие от первого тома, здесь мы переходим к практике: уровни, точки входа, работа с графиком. Это уже не просто теория — это инструменты, которые ты будешь применять в реальной торговле.

Материал основан на моём **12-летнем опыте**. Я совершил достаточно ошибок — сливал депозиты, игнорировал риски, торговал на эмоциях — чтобы переработать всё это в простые правила, которые можно повторить.

Если что-то не усваивается с первого раза — перечитывай, возвращайся. Понимание придёт.

Трейдинг — это профессия. Наберись терпения, и ты обязательно придёшь к своей цели.

С уважением,

Игорь Арапов

arapov.trade

Содержание

Часть I. Технический анализ рынка

Раздел 1. Основные фазы рыночного движения

Раздел 2. Уровни смены приоритета

Раздел 3. Характеристики разворотных движений

Часть II. Объёмный анализ

Раздел 4. Применение объёмов

Часть III. Метод входа в рынок

Раздел 5. Определение метода входа

Часть IV. Контроль рисков

Раздел 6. Управление капиталом

Раздел 7. Страх и надежда

Часть V. Математическая модель

Раздел 8. Прибыльная торговая система

Часть VI. Практика

Раздел 9. Торговая стратегия

Примеры торговой системы

Часть I. Технический анализ рынка

Рынок не движется хаотично — каждое его движение подчинено определённой логике и проходит через повторяющиеся фазы. Понимание этих фаз — фундамент трейдинга. Цель этой части — научиться определять, в какой фазе находится рынок сейчас, чтобы торговать в правильном направлении и не идти против потока.

Раздел 1. Основные фазы рыночного движения

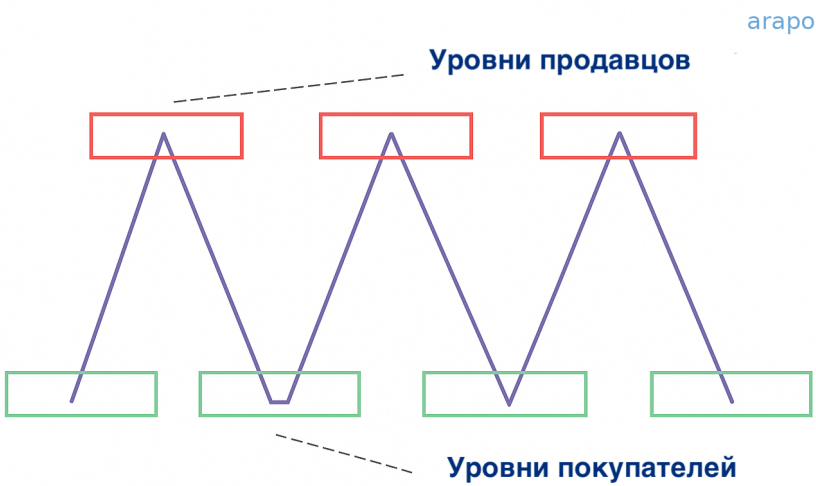


Рис. 1. Фаза баланса (равновесия)

Баланс характеризуется боковым движением с ясными границами и уровнями поддержки и сопротивления. В таком случае торгуем от границ: на «сопротивлении» продаём, на «поддержке» покупаем.

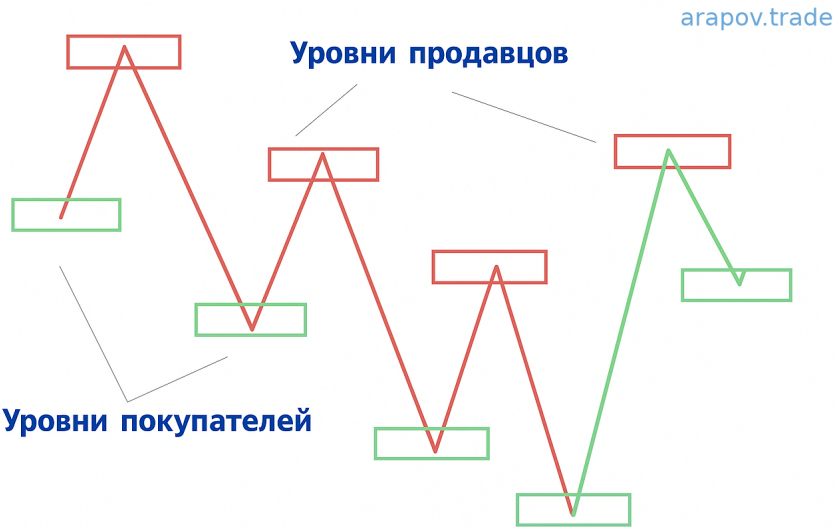


Рис. 2. Фаза тренда (дисбаланса)

Трендовая фаза движения характеризуется быстрым изменением цены в направлении тренда и медленным — в фазе отката. Различают два основных типа трендов:

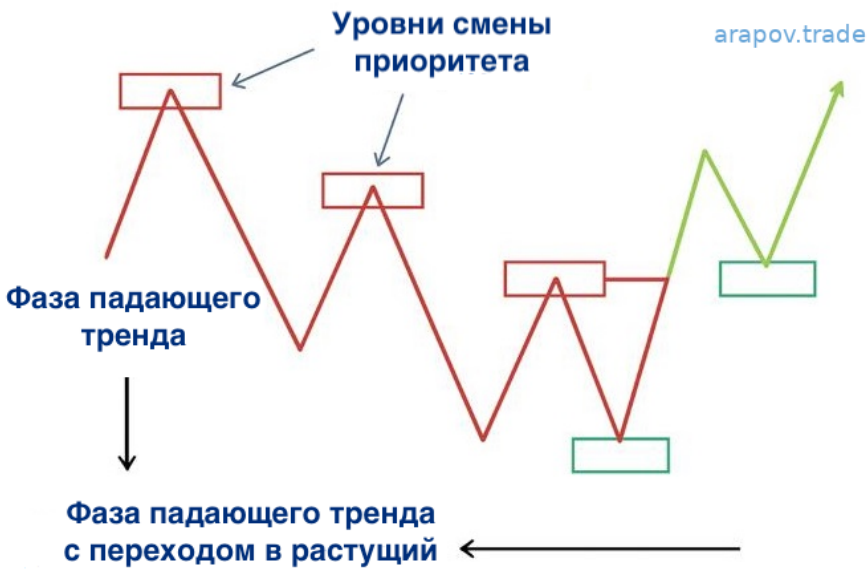
1. **Медвежий тренд** — характеризуется последовательным снижением максимумов и минимумов. Каждый новый пик и дно ниже предыдущих.
2. **Бычий тренд** — характеризуется последовательным повышением локальных максимумов и минимумов. Торговля ведётся только в

направлении действующего тренда.

Раздел 2. Уровни смены приоритета

Уровень Смены Приоритета (УСП) — это динамическая зона на графике, откуда начинается импульсное движение (волна покупок или продаж), которое приводит к обновлению ценовых экстремумов.

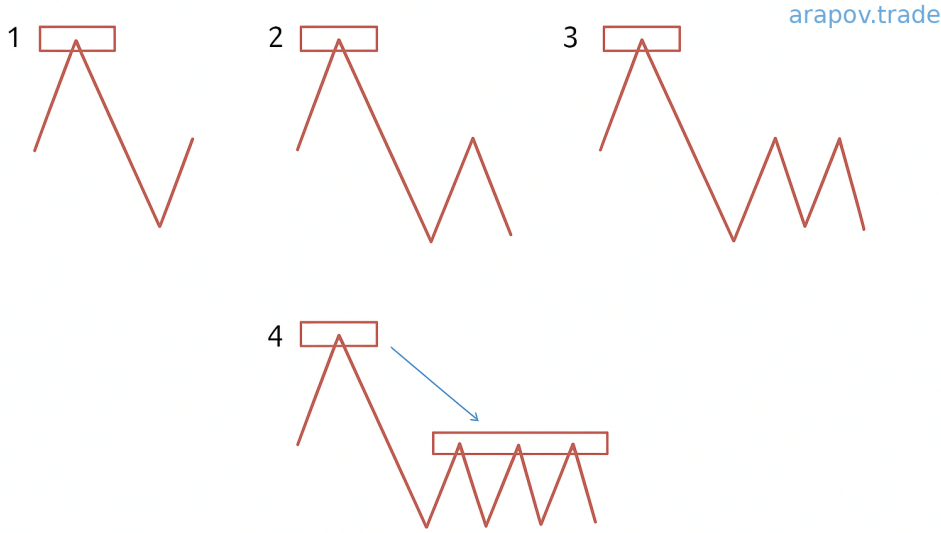
Этот уровень указывает на потенциальную активность и силу той стороны, которая в данный момент доминирует на рынке — будь то покупатели или продавцы. Наша основная задача — определить, кто владеет инициативой и контролирует текущее направление движения цены.



Схематический пример смены приоритета на ключевых уровнях

Также уровень смены приоритета образуется в областях удержания

цены (накопления позиций). Эта область определяется образованием уровня с тремя и более касаниями цены либо с помощью горизонтального объёма (ценовой уровень значительной проторговки).



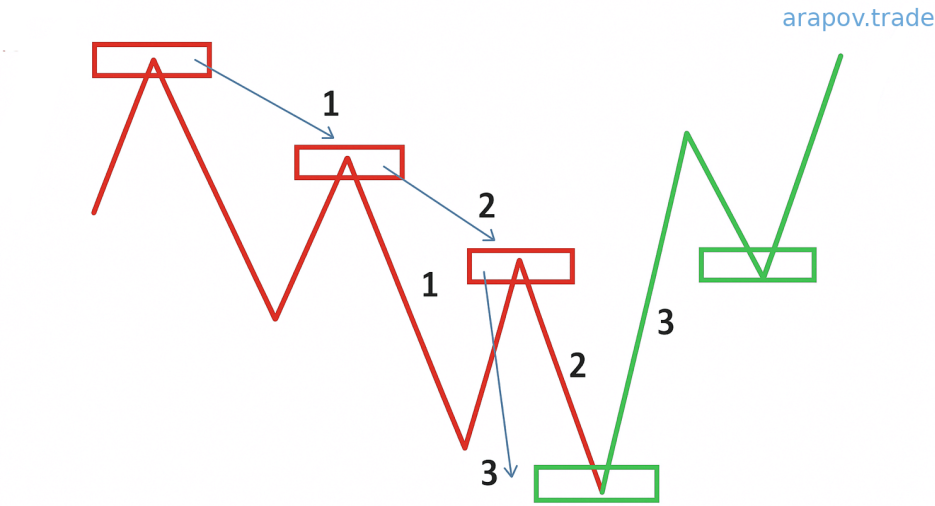
Схематический пример смены приоритета с областями удержания цены

Схематический пример: движение уровней приоритета

Движение уровней приоритета анализируется одинаково для

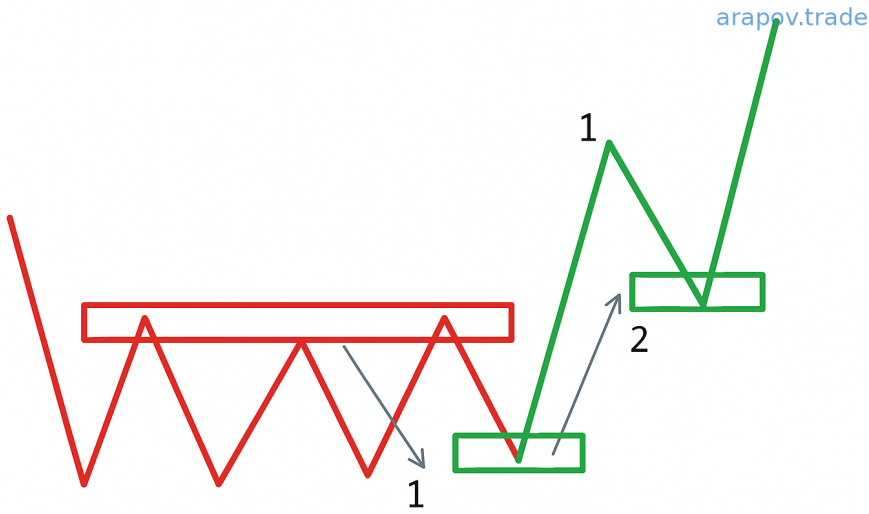
любых таймфреймов.

Пример 1. Разворот через ложный пробой



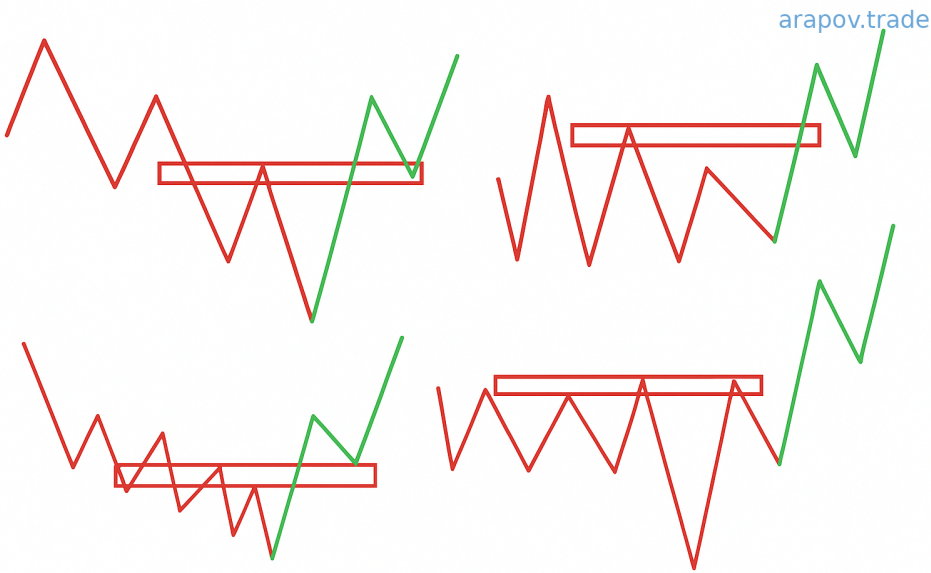
Общая схема движения УСП и разворота ценового движения без фазы баланса через «ложный пробой»

Пример 2. Разворот через фазу баланса



Общая схема движения УСП и разворота ценового движения через фазу баланса

Пример 3. Вариации разворотных моделей

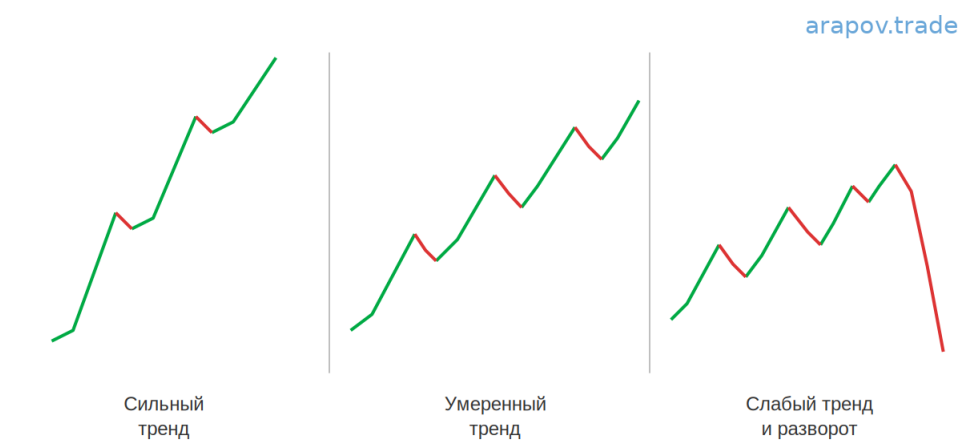


Раздел 3. Характеристики разворотных движений

Трендовые волны должны обладать признаками силы и быть агрессивными (быстрыми, импульсными) и более длинными, чем откатные.

Откатные волны должны обладать слабостью. Иногда откатные волны могут быть плоскими (похожими на баланс, «флетовыми») либо иметь несущественную контртрендовую динамику.

Ослабление трендовых волн и усиление контртрендовых является одним из признаков **слабого тренда**, который близок к развороту или балансу, но не является сигналом к смене тенденции.



Анализ силы трендовых и откатных волн

Анализ следует начинать с оценки разворотной волны, сравнивая

динамику трендовых и откатных движений. Это даёт понимание, как определить силу текущего тренда и позволяет оценить вероятность его продолжения.

Сильное движение — это быстрое движение! Быстрые, мощные импульсы с минимальными откатами указывают на доминирование одной стороны и высокую вероятность продолжения тенденции.

Возможны три варианта соотношения силы трендовых и откатных волн:

1. **Сильные трендовые и слабые откатные волны** — наиболее предпочтительный сценарий для торговли по тренду.
2. **Сила трендовых и откатных волн примерно равна** — динамика сбалансирована, часто указывает на консолидацию.
3. **Сила откатных волн превышает силу трендовых** — признак ослабления тренда и возможного разворота.

> *Раздел «Технический анализ рынка» даёт практические инструменты для прогнозирования движения цен. Ты научишься «читать» график, анализируя цену и поведение рынка. Освоишь уровни поддержки и сопротивления, тренды и свечные паттерны — это позволит точно определять точки входа и выхода из сделки.*

Часть II. Объёмный анализ

> *Цель этой части — познакомиться с биржевыми объёмами и их применением, понять, как объёмный анализ помогает увидеть намерения «крупных» участников рынка и определять их уровни интереса.*

Раздел 4. Применение объёмов

Торговый объём — это количество сделок, совершённых между покупателями и продавцами за определённый промежуток времени (вертикальный объём) либо на конкретной ценовой отметке (горизонтальный или кластерный объём).

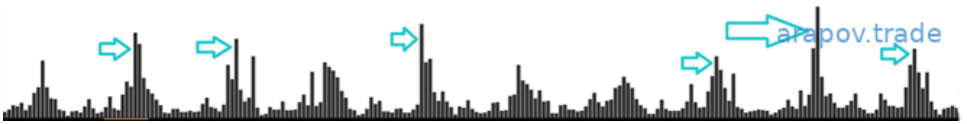
По сути, объём отражает активность трейдеров на конкретной цене или в заданном диапазоне. Как правило, именно ценовые уровни с выраженной объёмной активностью становятся наилучшими зонами для открытия или закрытия сделок.

В анализе объёма мы ищем **следы профессиональных участников рынка**, чтобы понять, в каком направлении они накапливают или распределяют позиции.

Ключевые аспекты анализа:

- **Повышенная объёмная активность** — крупные объёмы, всплески, кластеры. Это легко заметный вертикальный объём.

- **Пониженная активность** — указывает на отсутствие интереса и часто предшествует резким движениям.



Пример вертикального объёма

Связь объёма с динамикой цены

Ключевое в понимании объёмов — это связка «объём + цена = результат», которую также называют принципом **«усилие — результат»**.

Мы всегда рассматриваем торговый объём в контексте ценового движения, чтобы определить направление дисбаланса между покупателями и продавцами и оценить эффективность объёма.

Если объём высокий, но результат в цене слабый — это сигнал о возможной потере силы или поглощении. А если объём сопровождается сильным движением — значит, усилие дало результат, и сторона, стоящая за этим объёмом, контролирует рынок.

Схематический пример: принцип «усилие — результат»

Зона 1

На графике появляется бар роста с ультравысоким объёмом. Спред (ширина тела бара) заметно шире предыдущих. Это явное усилие со стороны покупателей. Однако вместо продолжения роста цена останавливается и переходит в боковое движение. Мы наблюдаем **усилие без результата** — первая слабость на рынке.

> Согласно методике Ричарда Вайкоффа: «Слабость рынка всегда проявляется на ап-барах, а сила — на даун-барах».

Когда рыночная «толпа» покупает, профессионалы продают — создаётся **ап-бар** с объёмом, но без результата (признак слабости рынка).

Когда рыночная толпа продаёт, профессионалы покупают —

создаётся **даун-бар** с объёмом, за которым может последовать рост (признак силы рынка).

Зона 2

Боковое движение рынка с неудачной попыткой подняться выше бара с ультравысоким объёмом. Формируется медвежий уровень смены приоритета. **Ложный пробой** отражает отсутствие интереса крупных участников двигать рынок в прошлом направлении.

Зона 3

Начало импульсного движения в новом направлении с формированием новых уровней смены приоритета. Дальнейшие сделки рекомендуется открывать исключительно в сторону импульсного движения. **Торговля по тренду — это залог успешной торговли на дистанции.**

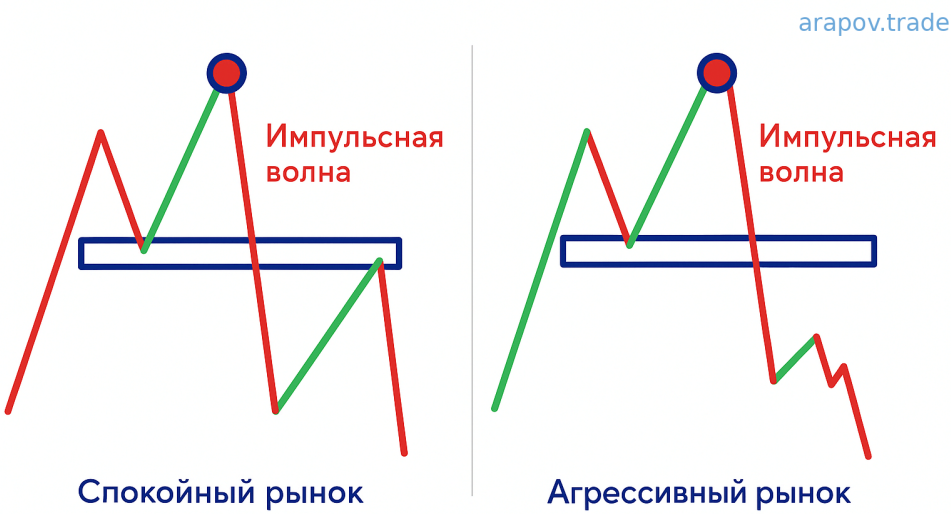
> *Объёмный анализ даёт глубокое понимание внутренней структуры рынка. Он позволяет определить, где находится рынок — накопление, рост, распределение или падение — и действовать соответственно. Ты научишься видеть «механику» рынка и отличать «умные деньги» от толпы.*

Часть III. Метод входа в рынок

Раздел 5. Определение метода входа

Задача: войти в рынок после импульсного движения на откате цены — по направлению импульса.

Откатное движение — во время пробоя поддержки/сопротивления срабатывают «стоп-лоссы» участников, которые верили в отбой от границы. Так как стоп-лосс — это обратный рыночный ордер, цену просто «размазывает» по графику. Затем участники, устроившие пробой, закрывают прибыль — так получается откат.



Схематический пример: точка входа в позицию

Волна 3 — импульсная волна на ультравысоком объёме с широким телом бара. Широкое тело говорит об «истерических» продажах по рынку (market sell orders).

Любой пробой консолидации неминуемо затрагивает стоп-лоссы тех трейдеров, которые торгуют от границ. Их массовые приказы «продать по рынку» растягивают цену вниз, создавая ультраширокий даун-бар.

> Я всегда жду откат цены до границы консолидации и только тогда принимаю решение о сделке. Участники рынка почти всегда возобновляют движение от тех цен, где изначально

прикладывали усилие!

Если пробой был **истинным** — возобновление продаж произойдёт от уровня пробоя. Если пробой был **ложным** («встряска») — мы увидим выход цены наверх.

В конкретном случае мы увидели, что цена подошла к зоне консолидации на ультранизком объёме и возобновила движение вниз. Наша точка входа была после формирования нового уровня смены приоритета на нисходящем рынке — после отката к «пробитой поддержке».

> *Этот раздел даёт понимание поведения крупных игроков и учит анализировать рынок с точки зрения ликвидности и намерений маркет-мейкеров. Ты начнёшь понимать, где накапливаются стоп-лоссы толпы и как крупные игроки используют их для открытия своих позиций.*

Часть IV. Контроль рисков

Раздел 6. Управление капиталом

Управление капиталом — это ключ к стабильному приросту депозита. Риск в отдельно взятой сделке прямо пропорционально зависит от опыта трейдера, но даже самые опытные могут ошибаться!

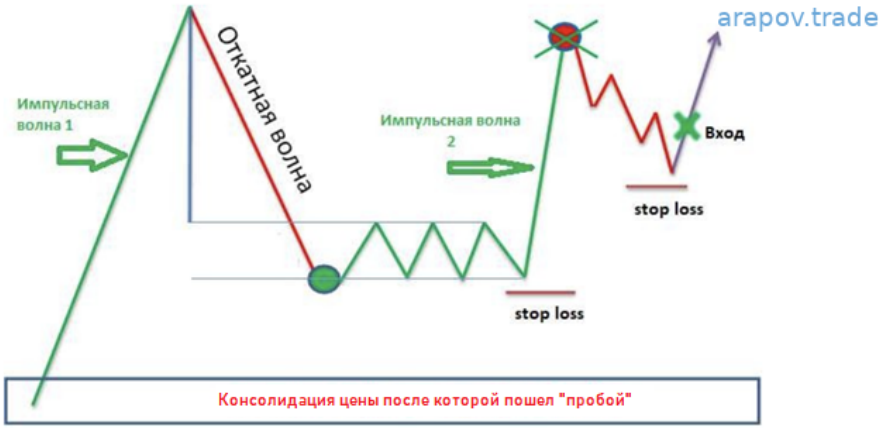
> В рынке нет ничего постоянного, поэтому никогда не позволяй себе рисковать слишком многим!

Твоя задача — оказаться на финише с суммой большей, чем ты был на старте. Отдельные убытки не должны помешать твоей цели.

Твой депозит и твой риск на сделку должны отвечать двум критериям:

- Должны быть комфортными для тебя на текущем этапе развития
- Не должны угрожать твоей финансовой безопасности

Ограничение убытка (Stop Loss)



Схематический пример постановки защитного ордера

Выбор размера стоп-приказа зависит от устанавливаемых целей. Стоп-приказ устанавливают, как правило, за локальный экстремум, который имеет признаки окончания откатного движения.

Раздел 7. Страх и надежда

Основная идея объёмного анализа заключается в том, что рыночными ценами движут страх и жадность. Именно на этих эмоциях профессиональные трейдеры ловят в ловушку «толпу» и забирают у неё деньги.

Эти эмоции напрямую влияют на торговые решения. Когда спекулянты боятся падения цен — они продают. Когда боятся упустить возможность заработать — покупают без достаточных оснований.

В моменты страха трейдеры думают: *«Как далеко может пойти цена против меня? Может ли ситуация ухудшиться?»*

Надежда — полная противоположность страха. Трейдеры концентрируются на положительных моментах, думая: *«Сколько я могу заработать на этой сделке?»*

Мышление профессионального трейдера

Профессиональные трейдеры по сути — **профессиональные игроки**. Главное — выработать правильное, ясное и сосредоточенное мышление.

Профессиональные трейдеры принимают риски, но тщательно ими управляют. Они ищут сделки с высокой вероятностью успеха и ставят только тогда, когда шансы на выигрыш высоки.

Многие начинающие трейдеры совершают ошибку, применяя мышление любителя к трейдингу. Они рассматривают торговлю как развлечение. Если вы серьёзно относитесь к трейдингу, жизненно важно изменить своё мышление.

> Не входите в сделку ради всплеска эмоций. Ищите ситуации с высокой вероятностью успеха и стойте в стороне, пока не появится благоприятный момент для входа. Действуйте как профессиональный игрок, который тщательно просчитывает риски.

Полезно рассматривать трейдинг как профессиональную азартную игру — это правильный взгляд. Однако не будьте игроком-любителем, а скорее «казино», которое тщательно рассчитывает вероятности, убеждается, что они на его стороне, и использует закон больших чисел.

Рынок создаёт множество ментальных «капканов»: от желания отыграться до эйфории после прибыли. Осознав их, трейдер учится не поддаваться эмоциям и избегать необдуманных решений.

Часть V. Математическая модель

> *Цель этой части — научиться работать по правилам, а не по эмоциям. Изучить правила торговой системы и применять математику для принятия обоснованных торговых решений.*

Раздел 8. Прибыльная торговая система

Математическая модель прибыльной системы состоит из трёх ключевых параметров: **стоп-лосс**, **соотношение риск/прибыль** и **вероятность** — соблюдение которых обязательно в любой ситуации.

Стоп-лосс ставим всегда

Отсекая убытки, ты не позволяешь рынку «залокировать» тебя в убыточных сделках. Это сохраняет твой капитал в работе. Худшее, что может случиться — это залоченные позиции, при которых у тебя просто не остаётся денег для торговли.

Соотношение риск к прибыли

Минимальное соотношение — **1 к 2**. Это значит, что рискуя 5 пунктами, твоя потенциальная прибыль должна быть минимум 10 пунктов, а лучше — больше: 15, 40, 100. Если такого соотношения нет, сделки не должно быть, каким бы привлекательным ни был сетап.

Вероятность

Рассмотрим 10 сделок с параметрами: стоп-лосс 5 пунктов, тейк-профит 10 пунктов. Результаты могут выглядеть так:

```
+10, +10, −5, +5, +10, +15, −5, −5, −5, −10
```

Итог: **-20 пунктов** без учёта комиссии.

> Вывод: рандомный трейдинг, даже при соотношении 1:2, скорее всего будет убыточным на длинной дистанции.

Пример с соотношением 1 к 3

Стоп-лосс — 5 пунктов, тейк-профит — 15 пунктов. При 10 сделках (40% убыточных, 60% прибыльных):

- Убытки: 4 × (-5) = -20 пунктов
- Прибыль: 6 × (+15) = +90 пунктов
- **Итого: +70 пунктов** (с учётом комиссий ~60 пунктов)

> При соотношении 1:3 можно позволить себе иметь меньше выигрышных сделок и при этом быть прибыльным, потому что каждая победа приносит существенно больше, чем проигрыш забирает.

Практика и отработка знаний

После изучения теоретического материала следующим шагом

становится **практика**. Необходимо открыть демонстрационный счёт у любого удобного брокера и начать применять полученные знания в реальных рыночных условиях.

На этом этапе ошибки неизбежны, и они не должны становиться причиной для остановки. **Трейдинг — это марафон.** Выигрывает не тот, кто случайно угадал направление одной сделки, а тот, кто стабильно зарабатывает на дистанции.

> Торговлю на реальные деньги рекомендую начинать только после того, как ты выполнишь не менее 100 сделок на демонстрационном счёте.

Часть VI. Практика

Раздел 9. Торговая стратегия

Торговая стратегия — это заранее разработанный набор чётких правил, регулирующих действия трейдера на всех этапах: от входа в сделку до выхода. Она устраняет импровизацию, эмоциональные колебания и субъективность, заменяя их логикой и статистикой.

Что должна включать торговая стратегия

1. **Условия входа в сделку** — пошаговый алгоритм от анализа рынка до открытия позиции.
2. **Условия выхода из сделки** — правила фиксации прибыли (тейк-профит) и ограничения убытков (стоп-лосс).
3. **Управление капиталом** — какой процент депозита использовать, как масштабировать позиции.
4. **Психология и дисциплина** — как сохранять хладнокровие и следовать системе.

Почему стратегия важна для новичков

Многие новички приходят на рынок с надеждой на лёгкий заработок, но без рабочей стратегии и понимания рисков. Результат? Хаотичная торговля, потеря депозита и разочарование.

Торговая система — это фундамент. Без неё трейдинг превращается в азартную игру на удачу, где ты заведомо в проигрыше из-за отрицательного математического ожидания.

Примеры торговой системы

Ниже представлены графики с примерами точек входа. Это не уникальные паттерны, а практическое применение теории, изложенной в курсе. Цель — показать направление развития для начинающих трейдеров.

Пример 1. Индекс Nasdaq (4 часа)

График TradingView — Индекс Nasdaq (NQ), ТФ — 4 часа

Классический пример работы с уровнями. В начале американской

торговой сессии на Nasdaq часто происходят ложные пробои с последующим трендовым движением в противоположном направлении.

Тот же график, ТФ — 15 мин

1. Диапазон сопротивления (21900-22000) со старшего ТФ
2. Пин-бар — первый признак проблем для покупателей
3. Ложный пробой уровня, сбор ликвидности
4. Паттерн «Медвежье поглощение» — вход в продажу
5. Постановка защитного ордера (стоп-лосс)
6. Цель — противоположный импульсный уровень

> Важно: на каждый 1 доллар риска закладывайте потенциал минимум 3 доллара прибыли. Расстояние до цели должно

быть в 3 раза больше, чем до стоп-ордера.

Пример 2. Bitcoin (4 часа)

Bitcoin, ТФ — 4 часа. Импульсная медвежья волна как уровень сопротивления

Bitcoin, ТФ — 15 мин

Аналогичная логика: уровень сопротивления → пин-бары → ложный пробой → медвежье поглощение → вход с соотношением 3:1.

Пример 3. Фьючерс на Евро (CME)

Фьючерс на Евро (аналог EUR/USD), ТФ — 4 часа

Импульсная медвежья волна как уровень сопротивления и зона интереса.

Пример 4. Bitcoin — продолжение

Bitcoin, ТФ — 4 часа

Bitcoin — детализация входа

Диапазон сопротивления (97000-98000). Та же последовательность: пин-бар, ложный пробой, медвежье поглощение, стоп-лосс за макушку бара, цель — противоположный уровень.

Пример 5. Nasdaq — внутридневная торговля

Nasdaq, ТФ — 2 часа

Пример «двойной вершины». В диапазоне ждём пин-бар, затем ложный пробой на повышенном объёме, медвежье поглощение — вход в продажу.

> В данном примере правило 3:1 не соблюдается, поэтому такую сделку необходимо пропускать, даже несмотря на появление точки входа.

Фьючерс на Евро, ТФ — 15 мин

Важно помнить про правило 3:1, где на каждый доллар риска мы хотим заработать минимум 3 доллара прибыли.

Заключение

Поздравляю! Ты прошёл второй том курса «Основы трейдинга». Теперь у тебя есть практические инструменты для работы на рынке: понимание фаз движения, уровней смены приоритета, объёмного анализа и чёткий метод входа.

Но помни: **знания без практики мертвы**. Открой демо-счёт, отработай минимум 100 сделок, веди статистику. Только после этого переходи к реальным деньгам.

Трейдинг — это марафон. Будь терпелив, дисциплинирован, и ты обязательно придёшь к своей цели.

Игорь Арапов

Профессиональный трейдер с 2013 года

arapov.trade

YouTube: @ArapovTrade

TradingView: ArapovTrade

Telegram: +38 050 293 30 75

© 2025 Игорь Арапов. Все права защищены.

Дисклеймер

ВАЖНО: Эта книга предназначена исключительно для образовательных целей и не является финансовой консультацией, инвестиционными рекомендациями или предложением купить или продать какие-либо финансовые инструменты.

Торговля на финансовых рынках связана со значительным риском потери средств и подходит не всем инвесторам. Прошлые результаты не гарантируют будущих. Вам следует тщательно оценить, подходит ли вам торговля с учётом вашего финансового положения.

Автор и издатель не несут ответственности за любые убытки, понесённые в результате использования информации, содержащейся в этой книге. Все торговые решения вы принимаете на свой страх и риск.

Перед принятием любых инвестиционных решений проконсультируйтесь с квалифицированным финансовым консультантом.

© 2025 Игорь Арапов. Все права защищены.